



BANCO CENTRAL
DE LA REPÚBLICA ARGENTINA

COMUNICACIÓN "B" 12034	7/7/2020
------------------------	----------

A LAS ENTIDADES FINANCIERAS:

Ref.: ***Tasas continuas de descuento para la medición del riesgo de tasa de interés en la cartera de inversión. Comunicación "A" 6397.***

Nos dirigimos a Uds. para comunicarles las tasas continuas de descuento al 30/06/2020 (Anexo I), a ser utilizadas por las entidades financieras dentro del marco estandarizado para la medición del riesgo de tasa de interés en la cartera de inversión (RTICI), según las normas sobre "Lineamientos para la gestión de riesgos en las entidades financieras" (Com. "A" 6397).

Saludamos a Uds. atentamente.

BANCO CENTRAL DE LA REPÚBLICA ARGENTINA

Silvina Ibañez
Subgerente de Regímenes Prudenciales
y Normas de Auditoría

Mariana A. Díaz
Gerente de Régimen
Informativo a/c

ANEXO



B.C.R.A.	Anexo a la Com. "B" 12034
----------	---------------------------------

Tasas continuas de descuento, a ser utilizadas por las entidades financieras dentro del marco estandarizado para la medición del riesgo de tasa de interés en la cartera de inversión (RTICI), según las normas sobre "Lineamientos para la gestión de riesgos en las entidades financieras" (Com. "A" 6397).

30.06.20

Punto medio de la banda temporal (t_k) en años	Tasa de interés continúa $R(t_k)$ en Pesos	Tasa de interés continúa $R(t_k)$ en Dólares
0,0028	24,80%	365,85%
0,0417	25,48%	339,47%
0,1667	27,54%	270,65%
0,375	30,54%	194,25%
0,625	33,49%	139,82%
0,875	35,85%	107,25%
1,25	38,48%	78,86%
1,75	40,70%	58,60%
2,5	42,16%	43,11%
3,5	42,13%	32,76%
4,5	41,06%	27,00%
5,5	39,66%	23,34%
6,5	38,23%	20,81%
7,5	36,91%	18,95%
8,5	35,74%	17,53%
9,5	34,72%	16,40%
12,5	32,46%	14,11%
17,5	30,28%	12,04%
25,0	28,62%	10,49%



BANCO CENTRAL
DE LA REPÚBLICA ARGENTINA